

GBMfondos

GBMDOL GBM FONDO DE INVERSION EN DOLARES, S.A. DE C.V., F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 05 DICIEMBRE, 2024

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
CHEQUERAS BANCARIAS EN DÓLARES						
CHD	JPMOR	7819175		9,227,600	186,437,197.61	3.96
EUROBONOS DE EMPRESAS PRIVADAS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
D2SP	BSMXH06	250417	BBB+	4,900	99,712,983.98	2.12
OTROS TIPO DE VALOR D2SP - EUROBONOS DE EMPRESAS PRIVADAS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
				5,260	143,999,148.15	3.06
TÍTULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
JISP	CABE251	250506	Aa3	6,600	132,072,004.85	2.80
TRACKS EXTRANJEROS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
1ISP	TFRN	N	ALTA	886,884	1,028,005,594.92	21.83
1ISP	IB01	N	ALTA	376,209	863,326,066.26	18.33
1ISP	FLOA	N	ALTA	6,397,309	789,348,987.81	16.76
1ISP	BIL	*	ALTA	352,165	651,116,281.29	13.82
1ISP	ERNA	N	ALTA	4,360,956	525,312,199.20	11.15
1ISP	VDCA	N	ALTA	224,424	261,676,174.10	5.56
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					4,681,006,638.17	99.38
OTROS VALORES				6,603,995	28,979,134.76	0.62
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					4,709,985,772.93	100.00

CATEGORÍA RVDIS

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
1.060%

Límite de VaR
2.400%

Para llevar a cabo la estimación del Valor en Riesgo (VaR) de mercado para las Fondos de Inversión administrados por Operadora GBM, se acordó con la empresa Valor de Mercado (Valmer) que sea ella quien lo realice, siguiendo los criterios metodológicos aprobados por la Unidad de Administración Integral de riesgos de la Operadora.

El método utilizado para la estimación del VaR es el conocido como simulación histórica, con los parámetros que se presentan a continuación:

- Un periodo de muestra de un año
- El nivel de confianza para el VaR fijado al 95%
- El horizonte temporal para el que se estime la posible minusvalía será de 1 día